

COMISIÓN NACIONAL DEL MERCADO DE VALORES

Dirección General de Mercados

Paseo de la Castellana, 15

28046 Madrid

COMUNICACIÓN DE HECHO RELEVANTE



BNP PARIBAS

NOTIFICA

EVENTO EXTRAORDINARIO

PSA Peugeot Citroën inicia un proceso de Ampliación de Capital con las siguientes características:

Nombre Compañía: PSA Peugeot Citroën

Reuters: PEUP.PA

Bloomberg: UG FP

ISIN: FR0000121501

Términos: 16 X 31 (= 16 acciones nuevas por cada 31 acciones viejas)

Precio Suscripción: 8,27 EUR

Período de Suscripción: [08/03/12, 21/03/12]

Fecha de Registro: 07/03/12

Precio de Cierre de PSA Peugeot Citroën en la Fecha de Registro (07/03/12): 13,21 EUR

EMISIONES AFECTADAS

Este evento extraordinario afectará a los siguientes instrumentos emitidos por BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V.:

	SIBE	ISIN	Producto	Tipo	Subyacente	Precio de Ejercicio / Nivel de Bonus		Nivel de Barrera	Paridad	Ratio	Fecha de Vencimiento
1	U0024	NL0009976596	BONUS CAP	BONUS CAP	PEUGEOT	EUR	18.4	8.1	1	1	15/03/13

AJUSTE

BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. aplicará el siguiente Factor de Ajuste sobre las características de las emisiones anteriores para que este evento extraordinario tenga un efecto económicamente neutral:

$$\text{Factor de Ajuste} = \left[\frac{AV}{AV+AN} \times \left(1 - \left(\frac{PS}{PC} \right) \right) \right] + \left(\frac{PS}{PC} \right) =$$

$$= \left[\frac{31}{31+16} \times \left(1 - \left(\frac{8.27 \text{ EUR}}{13.21 \text{ EUR}} \right) \right) \right] + \left(\frac{8.27 \text{ EUR}}{13.21 \text{ EUR}} \right) =$$

$$= 0.87269477$$

donde:

AN = Acciones Nuevas

AV = Acciones Viejas

PS = Precio de Suscripción

PC = Precio de Cierre en la Fecha de Registro

Nuevo Precio de Ejercicio (redondeado a 2 decimales) = Viejo Precio de Ejercicio x Factor de Ajuste

Nueva Paridad (redondeada a 4 decimales) = Vieja Paridad x Factor de Ajuste

Nuevo Ratio (redondeado a 4 decimales) = 1 / Nueva Paridad

NUEVAS CARACTERÍSTICAS DE LAS EMISIONES AFECTADAS

Una vez aplicado el ajuste anterior sobre las características de las citadas emisiones, éstas tendrán las siguientes características a partir del 08/03/2012 (incluido):

	SIBE	ISIN	Producto	Tipo	Subyacente	Precio de Ejercicio / Nivel de Bonus		Nivel de Barrera	Paridad	Ratio	Fecha de Vencimiento
1	U0024	NL0009976596	BONUS CAP	BONUS CAP	PEUGEOT	EUR	16.06	7.07	0.8727	1.1459	15/03/13

BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. comunica b anterior para conocimiento del público en general a los efectos oportunos.

En Madrid a 7 de Marzo de 2012